

<<基于Copula理论的金融风险相依结构模>>

图书基本信息

书名：<<基于Copula理论的金融风险相依结构模型及应用>>

13位ISBN编号：9787513605687

10位ISBN编号：7513605688

出版时间：2011-5

出版时间：中国经济

作者：易文德

页数：181

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<基于Copula理论的金融风险相依结构模>>

### 内容概要

相依性研究是金融风险领域中的一个重要问题，组合投资、资产定价、波动的传导和风险管理等问题都涉及相依性研究。

本书在考虑金融时间序列波动特点的基础上，建立了几个基于Copula理论的模型以研究金融时间序列之间的相依结构，研究了模型参数估计的性质和模型选择等问题，并把Copula模型应用于金融时间序列相依结构的研究分析上。

## 作者简介

易文德 男，汉族，江西宜春人，重庆文理学院数学与统计学院副教授，西南交通大学经济与管理学院博士。

研究领域为概率统计、计量经济、风险分析。

近五年，在《Journal of Statistical Planning and Inference》等国外期刊及《系统工程理论与实践》、《系统工程》、《管理评论》、《数学的实践与认识》、《西南大学学报》等国内期刊上共发表论文30余篇，其中，被SCI收录1篇，EI收录10余篇。

主持省部级课题两项，主研国家自然科学基金课题一项，2008年和2010年到香港城市大学进行交流研究工作。

书籍目录

摘要

第1章 绪论

- 1.1 研究的问题与研究的意义
- 1.2 国内外研究现状
  - 1.2.1 时间序列的建模研究
  - 1.2.2 Copula理论研究
  - 1.2.3 基于Copula理论的相依结构模型
  - 1.2.4 相关性传统分析方法的不足与缺陷
  - 1.2.5 基于Copula函数研究相依关系的优越性
- 1.3 本书的研究方法和技术路线
  - 1.3.1 本书的研究方法
  - 1.3.2 本书的技术路线

第2章 Copula理论及其在金融风险分析中的应用

- 2.1 Copula函数理论
  - 2.1.1 Copula函数的定义和定理
  - 2.1.2 Copula函数的基本性质
  - 2.1.3 几类Copula函数
- 2.2 相依结构及一致性相依测度
  - 2.2.1 几种重要的一致性测度
  - 2.2.2 尾部的几个条件概率和条件期望
- 2.3 Copula理论在金融风险管理中的应用
  - 2.3.1 相关的时间序列分析知识
  - 2.3.2 Copula函数与时间序列模型
  - 2.3.3 Copula函数与风险管理
- 2.4 本章小结

第3章 Copula模型构建方法及参数估计性质

- 3.1 Copula模型的构建步骤方法
  - 3.1.1 边缘分布的确定
  - 3.1.2 Copula函数模型的确定
- 3.2 马尔科夫(Markov)时间序列模型及参数估计性质
  - 3.2.1 一阶马尔科夫时间序列模型
  - 3.2.2 二阶段准极大似然参数估计性质
- 3.3 本章小结

第4章 基于Copula函数的金融时间序列相依结构模型

- 4.1 基于Copula函数二维时间序列相依模型的构建
- 4.2 模型参数的估计及其参数估计的性质
  - 4.2.1 模型参数估计的三阶段极大似然方法
  - 4.2.2 三阶段准极大似然估计的一致性和近似正态性的假设条件
  - 4.2.3 三阶段准极大似然估计的一致性和近似正态性
- 4.3 三阶段估计的Copula模型选择及准参数似然比统计量的近似性质
  - 4.3.1 Copula模型选择方法
  - 4.3.2 参数准似然比统计量(PPLR)的近似性质
- 4.4 模型的Monte—Carlo模拟
  - 4.4.1 模型的Monte—Carlo模拟方法
  - 4.4.2 模型的Monte—Carlo模拟实例

4.5 多维时间序列的相依模型

4.5.1 多维时间序列相依模型构建

4.5.2 多维模型的三阶段准极大似然参数估计

.....

第5章 基于Copula函数模型的股价与交易量相依结构研究

第6章 其他几个相依结构模型

参考文献

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>